

# 上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

**重要提示：**

1. 投资有风险,投资者认购基金时应认真阅读招募说明书;
2. 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益;
3. 本招募说明书所载基金招募说明书摘要,经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系的法律文件。基金管理人自基金合同取得基金财产,即成为基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并视《基金合同》、《托管协议》、《基金合同》及其他有关规范性文件,承担基金合同约定的相应义务,投资者亦应当认真阅读基金合同、托管协议、基金合同及其他有关规范性文件,并承担基金合同约定的相应义务;
4. 本招募说明书所载内容截止日为2012年9月25日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2012年9月30日,除特别说明外,下同。

二零一二年十一月

**一、基金的投资**

本基金的投资范围为全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或向天然资源行业提供服务的公司的股票,通过积极主动的资产配置和组合管理,在风险可控的前提下追求长期资产增值。

本基金的投资范围包括:

- (一) 股票范围
- (二) 债券范围
- (三) 权证范围
- (四) 其他金融工具

本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的60%-95%,现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的0%-40%,并持有不低于基金资产净值的5%或前一日收盘价以内政府债券。股票及其他权益类证券是指中国证监会允许投资的普通股、优先股、定向增发、公募股票基金等。现金、债券等中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及中国证监会认可的国债金融组织发行的债券(中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品)。

本基金投资于全球多元化的投资组合,本基金股票及其他权益类资产中持有不低于80%的部分投资于全球天然资源领域内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或向天然资源行业提供服务的上市公司,主要包括三大行业:①能源,如石油天然气的开采、加工、销售及运输;煤炭开采及服务;②基本金属和矿,如铜、铝等有色金属的采与加工;③工业产品,如橡胶、化肥等。所投资的股票在CSI全球分类标准中分为:能源和材料。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可以根据其纳入投资范围。

**(四) 投资策略**

随着全球人口数量的增长和全球经济的发展,全球对天然资源的需求正在自增,特别是新兴市场为“代表”的大宗商品和能源成为全球主要大宗商品,也是全球天然资源消费的主要地区。天然资源的稀缺及不可再生性与需求不断增大之间的矛盾日益显著其战略价值,从长期来看天然资源的价值在逐渐提升。从近期来看,由于全球金融危机后各国政府尤其是欧美国家在天然资源领域加大行政干预,实行严格的资源政策,造成大量资金流入到天然资源领域,造成全球天然资源价格飙升,天然资源领域的勘探、开发、生产及销售,或是向天然资源行业提供服务的公司获益明显。本基金通过深入挖掘全球天然资源领域内具有上市公司投资价值,优化资产配置,采用行业和企业相结合的领导方式,实现资产的增值。

**(五) 资产配置**

随着全球人口数量的增长和全球经济的不断发展,全球对天然资源的需求正在自增,特别是新兴市场为“代表”的大宗商品和能源成为全球主要大宗商品,也是全球天然资源消费的主要地区。天然资源的稀缺及不可再生性与需求不断增大之间的矛盾日益显著其战略价值,从长期来看天然资源的价值在逐渐提升。从近期来看,由于全球金融危机后各国政府尤其是欧美国家在天然资源领域加大行政干预,实行严格的资源政策,造成大量资金流入到天然资源领域,造成全球天然资源价格飙升,天然资源领域的勘探、开发、生产及销售,或是向天然资源行业提供服务的公司获益明显。本基金通过深入挖掘全球天然资源领域内具有上市公司投资价值,优化资产配置,采用行业和企业相结合的领导方式,实现资产的增值。

本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或向天然资源行业提供服务的公司的股票,通过积极主动的资产配置和组合管理,在风险可控的前提下追求长期资产增值。

本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的60%-95%,现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的0%-40%,并持有不低于基金资产净值的5%或前一日收盘价以内政府债券。

股票及其他权益类证券是指中国证监会允许投资的普通股、优先股、定向增发、公募股票基金等。现金、债券等中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及中国证监会认可的国债金融组织发行的债券(中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品)。

本基金投资于全球多元化的投资组合,本基金股票及其他权益类资产中持有不低于80%的部分投资于全球天然资源领域内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或向天然资源行业提供服务的上市公司,主要包括三大行业:

①能源,如石油天然气的开采、加工、销售及运输;煤炭开采及服务;②基本金属和矿,如铜、铝等有色金属的采与加工;③工业产品,如橡胶、化肥等。所投资的股票在CSI全球分类标准中分为:能源和材料。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可以根据其纳入投资范围。

**(六) 业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:MSCI全球股票指数收益率\*60%+人民币定期存款利率\*40%

注:1、MSCI全球股票指数指MSCI全球股票指数(人民币)。

2、人民币定期存款指一年期人民币定期存款。

3、本报告所指业绩比较基准的数据及存托凭证投资组合

序号 证券代码 公司名称(中文) 公司名称(英文) 所属证券市场 所属国家(地区) 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 NEM US Newmont Mining Corp -- 纽约证券交易所 美国 5,147 1,828,005.48 4.13

2 K CN Kinross Gold Corp -- 多伦多证券交易所 加拿大 27,074 1,755,234.43 3.97

3 FCM US Freeport-McMoran Copper & Gold Inc -- 纽约证券交易所 美国 6,626 1,662,972.14 3.76

4 NCU US Newcrest Mining Ltd -- 澳大利亚证券交易所 澳大利亚 7,762 1,491,463.11 3.37

5 YHI CN Yamana Gold Inc -- 多伦多证券交易所 加拿大 11,134 1,347,508.53 3.04

6 BP/ LN BP plc -- 伦敦证券交易所 英国 28,888 1,297,831.71 2.93

7 RBSB LN Royal Dutch Shell plc -- 荷兰证券交易所 荷兰 5,659 1,280,218.32 2.89

8 TRC-B US TRC Resources Ltd -- 多伦多证券交易所 加拿大 6,128 1,145,648.02 2.59

9 BTU US Peabody Energy -- 纽约证券交易所 美国 8,059 1,139,066.23 2.57

10 RSC AU Resolute Mining Ltd -- 澳大利亚证券交易所 澳大利亚 87,588 1,123,346.01 2.54

注:1、所用证券代码采用 ticker 代码。

2、所属行业及公允价值指在证券交易所上市所在国家(地区)。

3、本报告所指业绩比较基准的数据及存托凭证投资组合

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1 ETF5 Physical Platform ETF ETF Securities Ltd 652,333.52 1.47

10 投资组合管理责任

10.1 报告期内本基金前十名股票的投资组合

10.2 报告期内本基金前十名债券的投资组合

10.3 其他投资组合构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存托凭证组合 --

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 105,545.03

4 应收利息 84,108.20

5 应收申购款 2,641.19

6 其他应收款 1,883,263.51

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 2,075,557.93

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.6 投资组合报告附注

10.7 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.8 报告期内本基金投资的前十名股票没有存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9 其他投资组合构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存托凭证组合 --

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 105,545.03

4 应收利息 84,108.20

5 应收申购款 2,641.19

6 其他应收款 1,883,263.51

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 2,075,557.93

10.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

10.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.12 投资组合报告附注

10.13 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.14 报告期内本基金投资的前十名股票没有存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.15 其他投资组合构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存托凭证组合 --

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 105,545.03

4 应收利息 84,108.20

5 应收申购款 2,641.19

6 其他应收款 1,883,263.51

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 2,075,557.93

10.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

10.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.18 投资组合报告附注

10.19 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.20 报告期内本基金投资的前十名股票没有存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.21 其他投资组合构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存托凭证组合 --

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 105,545.03

4 应收利息 84,108.20

5 应收申购款 2,641.19

6 其他应收款 1,883,263.51

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 2,075,557.93

10.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

10.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

10.24 投资组合报告附注

10.25 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有发生被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.26 报告期内本基金投资的前十名股票没有存在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.27 其他投资组合构成

序号 名称 金额(人民币元)

1 存托凭证组合 --

2 应收证券清算款 --

3 应收股利 105,545.03

4 应收利息 84,108.20

5 应收申购款 2,641.19

6 其他应收款 1,883,263.51

7 待摊费用 --

8 其他 --

9 合计 2,075,557.93

注:截至2012年9月30日,本基金资产净值为44,262,559.45元,基金份额净值为1.054元,累计基金份额净值为1.054元。

2 报告期末在各个国家(地区)证券市场中的股票及存托凭证投资组合

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 39,454,700.43 65.72

其中:普通股 --

优先股 --

定向增发 --

其他金融产品 --

2 基金投资 652,333.52 1.09

3 固定收益投资 --

其中:债券 --

资产支持证券 --

4 金融衍生品投资 --

其中:中期 --

短期 --

权证 --

5 买入返售金融资产 --

其中:买断式回购的买入返售金融资产 --

6 货币市场工具 --

7 银行存款和拆借资产合计 17,850,660.01 29.73

8 其他各项资产 2,075,557.93 3.46

9 合计 60,033,251.92 100.00

注:截至2012年9月30日,本基金资产净值为44,262,559.45元,基金份额净值为1.054元,累计基金份额净值为1.054元。

2 报告期末在各个国家(地区)证券市场中的股票及存托凭证投资组合

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 39,454,700.43 65.72

其中:普通股 --

优先股 --

定向增发 --

其他金融产品 --

2 基金投资 652,333.52 1.09

3 固定收益投资 --

其中:债券 --

资产支持证券 --

4 金融衍生品投资 --

其中:中期 --

短期 --

权证 --

5 买入返售金融资产 --

其中:买断式回购的买入返售金融资产 --

6 货币市场工具 --

7 银行存款和拆借资产合计 17,850,660.01 29.73

8 其他各项资产 2,075,557.93 3.46

9 合计 60,033,251.92 100.00

注:截至2012年9月30日,本基金资产净值为44,262,559.45元,基金份额净值为1.054元,累计基金份额净值为1.054元。

2 报告期末在各个国家(地区)证券市场中的股票及存托凭证投资组合

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 39,454,700.43 65.72

其中:普通股 --

优先股 --

定向增发 --

其他金融产品 --

2 基金投资 652,333.52 1.09

3 固定收益投资 --

其中:债券 --

资产支持证券 --

4 金融衍生品投资 --

其中:中期 --

短期 --

权证 --

5 买入返售金融资产 --

其中:买断式回购的买入返售金融资产 --

6 货币市场工具 --

7 银行存款和拆借资产合计 17,850,660.01 29.73

8 其他各项资产 2,075,557.93 3.46

9 合计 60,033,251.92 100.00

注:截至2012年9月30日,本基金资产净值为44,262,559.45元,基金份额净值为1.054元,累计基金份额净值为1.054元。

2 报告期末在各个国家(地区)证券市场中的股票及存托凭证投资组合

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 39,454,700.43 65.72

其中:普通股 --

优先股 --

定向增发 --

其他金融产品 --

2 基金投资 652,333.52 1.09

3 固定收益投资 --

其中:债券 --

资产支持证券 --

4 金融衍生品投资 --

其中:中期 --

短期 --

权证 --

5 买入返售金融资产 --

其中:买断式回购的买入返售金融资产 --

6 货币市场工具 --

7 银行存款和拆借资产合计 17,850,660.01 29.73

8 其他各项资产 2,075,557.93 3.46

9 合计 60,033,251.92 100.00

注:截至2012年9月30日,本基金资产净值为44,262,559.45元,基金份额净值为1.054元,累计基金份额净值为1.054元。

2 报告期末在各个国家(地区)证券市场中的股票及存托凭证投资组合

序号 项目 金额(人民币元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 39,454,700.43 65.72

其中:普通股 --

优先股 --

定向增发 --

其他金融产品 --

2 基金投资 652,333.52 1.09

3 固定收益投资 --

其中:债券 --

资产支持证券 --

4 金融衍生品投资 --

其中:中期 --

短期 --

权证 --

5 买入返售金融资产 --

其中:买断式回购的买入返售金融资产 --

6 货币市场工具 --